

Requerimientos de capital por las exposiciones frente a CRCC a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva

31 de Marzo de 2020

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Renta Fija	Swaps
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	22	25	5
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	3,214	4,183	117
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	77,160	100,410	2,800
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	70,145	92,377	1,680
DF = DFCCP + DFCM	73,360	96,560	1,797
Σ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	71	12,636	3,706
<b>KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>1</b>	<b>202</b>	<b>59</b>
<b>Fórmula seleccionada en el cálculo de K*CM</b>	<b>3</b>	<b>3</b>	<b>3</b>
c1, Factor de capital decreciente que se aplica al excedente de garantía colectiva	0.16%	0.25%	0.58%
<b>K*CM = c1*DFCM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>112.23</b>	<b>232.25</b>	<b>9.66</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.5020	0.4273	0.9799
Método de asignación del C-factor	DFI/DFCM	DFI/DFCM	DFI/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.5522	1.4645	2.6332
<b>C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador</b>	<b>0.226%</b>	<b>0.339%</b>	<b>0.909%</b>
KCMI si DFI = 1.000	2.26	3.39	9.09